# 摩根士丹利中债 AAA 科技创新债券指数证券投资基金（大摩中债 AAA 科技创新债券指数 C 份额）

# 基金产品资料概要

编制日期：2026 年 11 月 20 日

送出日期：2026 年 11 月 21 日

**本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。**

**作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。**

## 一、产品概况

| | | | |
|---|---|---|---|
| **基金简称** | 大摩中债 AAA 科技创新债券指数 | **基金代码** | 029640 |
| **下属基金简称** | 大摩中债 AAA 科技创新债券指数 C | **下属基金交易代码** | 029641 |
| **基金管理人** | 摩根士丹利基金管理（中国）有限公司 | **基金托管人** | 华夏银行股份有限公司 |
| **基金合同生效日** | - | **上市交易所及上市日期** | 暂未上市 |
| **基金类型** | 债券型 | **交易币种** | 人民币 |
| **运作方式** | 普通开放式 | **开放频率** | 每个开放日 |
| **基金经理** | 陈言一 | **开始担任本基金基金经理的日期** | - |
| | | **证券从业日期** | 2013 年 08 月 12 日 |
| **其他** | 基金合同生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现前述情形的，本基金将根据基金合同第十九部分的约定进行基金财产清算并终止，而不需召开基金份额持有人大会。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。<br>本基金暂不向个人投资者销售，如未来本基金开放向个人投资者公开销售或对销售对象的范围予以进一步限定，基金管理人将另行公告。 | | |

## 二、基金投资与净值表现

### (一)投资目标与投资策略

详见《招募说明书》第九部分“基金的投资”

| | |
|---|---|
| **投资目标** | 本基金紧密跟踪标的指数，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 |
| **投资范围** | 本基金主要投资于标的指数的成份券及备选成份券。为更好实现投资目标,还可以投资于具有良好流动性的金融工具，包括除标的指数成份券及备选成份券以外的公开发行的债券（国债、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债、企业债、公司 |

| | |
|---|---|
| | 债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券及其他中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、信用衍生品、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。<br>本基金不投资于股票，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。<br>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。<br>基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，本基金投资于标的指数成份券、备选成份券的比例不低于本基金非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%， 其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。<br>如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。 |
| **主要投资策略** | 本基金为指数型基金，采用抽样复制和动态最优化的方法为主，选取标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，构建与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的指数的有效跟踪。<br>在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。<br>本基金运作过程中，当标的指数成份券发生明显负面事件面临违约，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整。<br>1、资产配置策略<br>本基金将采用抽样复制和动态最优化的方法，主要以标的指数的成份券构成为基础，综合考虑债券流动性、基金日常申购赎回以及银行间和交易所债券交易特性及交易惯例等情况，进行替代优化，以保证对标的指数的有效跟踪。<br>2、信用债投资策略<br>在构建信用债投资组合时，本基金将采取行业配置与个券评级跟踪相结合的投资策略，投资于外部债项信用等级为 AA+及以上的债券。<br>3、国债期货交易策略<br>基金管理人将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，谨慎进行国债期货交易。<br>4、信用衍生品投资策略<br>本基金在进行信用衍生品投资时，将根据风险管理的原则，以风险对冲为目的参与信用衍生品交易，获取信用衍生品标的债券的信用风险保护，改善组合的风险收益特性。<br>未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定并履行适当程序后，相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。 |
| **业绩比较基准** | 中债-AAA 科技创新债券财富(总值)指数收益率×95%+活期存款基准利率×5% |

| | |
|---|---|
| **风险收益特征** | 本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益理论上低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。<br>本基金为指数型基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征。 |

## 三、投资本基金涉及的费用

### (一)基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

| 费用类型 | 份额（S）或金额（M）/持有期限（N） | 收费方式/费率 |
|---|---|---|
| 赎回费 | N＜7 天 | 1.50% |
| | 7 天≤N＜30 天 | 1.00% |
| | N≥30 天 | 0.00% |

注：1、本基金的 C 类份额在认购、申购时不收取认购费、申购费,而是从本类别基金资产中计提销售服务费,销售服务费收取情况详见《招募说明书》。

2、本基金的 C 类基金份额暂不开放直销机构销售。

### (二)基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

| 费用类别 | 收费方式/年费率或金额 | 收取方 |
|---|---|---|
| **管理费** | 0.15% | 基金管理人和销售机构 |
| **托管费** | 0.05% | 基金托管人 |
| **销售服务费** | 0.10% | 销售机构 |
| **其他费用** | 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费、会计师费、律师费、基金份额持有人大会费用、基金的银行汇划费用等费用，以及按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。费用类别详见本基金《基金合同》及《招募说明书》或其更新。 | |

注：1、本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

2、通过直销机构持有的本基金 C 类基金份额不收取销售服务费，通过直销机构以外的其他销售机构持有的本基金 C 类基金份额且持续持有期限未超过 1 年的，收取销售服务费。

## 四、风险揭示与重要提示

### (一)风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。基金风险表现为基金收益的波动，基金管理过程中任何影响基金收益的因素都是基金风险的来源。基金的风险按来源可以分为市场风险、管理风险、流动性风险、操作风险、合规性风险、政策变更风险、税收风险、本基金特有的风险、法律风险和其他风险。

1、本基金的特有风险主要包括：

1）标的指数的风险

2）标的指数变更的风险

3）标的指数波动的风险

4）指数编制机构停止服务的风险

5）基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

6）跟踪误差控制未达约定目标的风险

7）本基金为债券型基金，主要投资于固定收益类品种。因此，本基金需要承担由于市场利率波动造成的利率风险、债券发债主体的信用风险以及发债主体信用恶化造成的信用风险，如果持有的信用债出现评级下调或信用违约风险，将给基金净值带来较大的负面影响和波动；如果债券市场出现整体下跌，将无法完全避免债券市场系统性风险。

8）本基金参与国债期货交易的风险

9）本基金投资于资产支持证券的风险

10）信用衍生品投资风险

2、关于本基金完整的风险揭示请见本基金招募说明书的“风险揭示”章节。

**(二)重要提示**

中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

根据本基金《基金合同》的约定，各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交深圳国际仲裁院，按照深圳国际仲裁院届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为深圳市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有决定，仲裁费用由败诉方承担。

基金产品资料概要信息发生变更的，基金管理人将按法规要求更新。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确的获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告、定期公告等披露文件。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站【https://www.morganstanleyfunds.com.cn】【客服电话：400-8888-668】

1、基金合同、托管协议、招募说明书

2、定期报告、包括基金季度报告、中期报告和年度报告

3、基金份额净值

4、基金销售机构及联系方式

5、其他重要资料